

# 万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要

2017年第1号)

基金管理人:万家基金管理有限公司  
基金托管人:宁波银行股份有限公司  
二零一七年六月

重要提示:万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2015年8月17日经中国证监会证监许可[2015]1950号文批准募集,并于2015年10月12日获得中国证监会机构函[2015]2621号文《关于募集备案的函》,合同生效日期为2016年11月11日。

基金管理人对招募说明书的内容进行审阅,但不保证其内容真实、准确、完整。

本招募说明书已经中国证监会注册,但中国证监会不对本基金募集的注册,并不表示对本基金的投资价值和收益作出实质性判断或保证,也不表示投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,既可能使您因证券市场波动等因素蒙受损失,投资人

在投资本基金前,应仔细阅读基金合同,全面认识本基金产品的风

险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)本基金的时机、数量及投资品种等作出独立判断,投资人根据所持有的基金份额享受权利并承担风险。本基金在投资运作过程中可能面临各种风险,包括但不限于:系统性风险、基金管理人管理风格变化影响所形成的风险、政策风险、操作风险、流动性风险、信用风险、技术风险、市场风险、环境经营层风险以及行业政策风险等。

本基金是混合型基金,其风险收益特征与股票型基金相似,但低于股票型基金。

本基金将根据运用类别配置、久期管理、券种选择和差

价策略,通过定性与定量分析,构建不同类型的资产建立

和维持核心股票,从而确保具有较高成长性的估值有吸引力的公司的股票进行投资,同时将风险意识贯穿于股票投资过程中,对投资标的进行持续严格的评价和评估。

3. 权益投资策略

基金管理人以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的

基础上,充分考量可投资品种的稳定性、流动性及风险收益特征,通过资产配置、

品种类属选择、择时投资规避风险,追求稳定的风险调整后收益。

4. 普通债券投资策略

在债券投资部分,本基金在债券组合平均久期、期限结构和类属配置的基

础上,充分考虑流动性、票息收入、信用风险、期限及付息频率、

税收、赎回、回购、转股等因素的影响,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

5. 中小企业私募债券投资策略

本基金将综合运用类别配置、久期管理、券种选择和差

价策略,通过深入研究企业基本面,结合宏观经济、行业

内部及外部环境,对中小企业私募债的信用风险、

流动性风险、操作风险、法律风险、政策风险、

信用风险、技术风险、市场风险、环境经营层风险以及行

业政策风险等,定期评估、预测和监控,并结合其业

绩并适时调整,以降低投资风险。

6. 股权投资策略

本基金将综合运用类别配置、久期管理、券种选择和差

价策略,通过深入研究企业基本面,结合宏观经济、行业

内部及外部环境,对中小企业私募债的信用风险、

流动性风险、操作风险、法律风险、政策风险、

信用风险、技术风险、市场风险、环境经营层风险以及行

业政策风险等,定期评估、预测和监控,并结合其业

绩并适时调整,以降低投资风险。

7. 债券投资策略

本基金将综合运用类别配置、久期管理、券种选择和差

价策略,通过深入研究企业基本面,结合宏观经济、行业

内部及外部环境,对中小企业私募债的信用风险、

流动性风险、操作风险、法律风险、政策风险、

信用风险、技术风险、市场风险、环境经营层风险以及行

业政策风险等,定期评估、预测和监控,并结合其业

绩并适时调整,以降低投资风险。

8. 股票投资策略

在股权投资阶段上,本基金以避险保值和有效管理为目标,在控制风险的前提下,

谨慎选择参与股权投资的基金。本基金将在股权投资中,通过分析股权投资的

风险和收益情况,把握投资机会,并结合流动性、交易活跃度、

投资组合的配置比例,选择价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳健

的投资收益。

9. 其他投资策略

本基金将综合运用类别配置、久期管理、券种选择和差

价策略,通过深入研究企业基本面,结合宏观经济、行业

内部及外部环境,对中小企业私募债的信用风险、

流动性风险、操作风险、法律风险、政策风险、

信用风险、技术风险、市场风险、环境经营层风险以及行

业政策风险等,定期评估、预测和监控,并结合其业

绩并适时调整,以降低投资风险。

10. 基金的投资限制

1. 组合限制

(1) 本基金投资于单只基金的资产净值比例50%~95%;

(2) 任何一只基金的总资产不得超过基金净资产的5%

当不低于基金净资产5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(3) 本基金持有一家同一银行发行的多个品种的,其市值不得超过基金净资产的10%;

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家同一银行发行的证券,不得超过该证券的10%;

(5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金净资产的3%;

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金净资产净值的0.5%;

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超越超过该证券的10%;

(9) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金净资产的30%;

(10) 本基金持有的单一国债期货合约的头寸不得超过其保证金的10%;

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于国债期货的,不得超过基金净资产的10%;

(12) 本基金投资于国债期货的,应当符合中国证监会的规定,并按规定的报告期披露相关信息;

(13) 本基金投资于股票发行后未上市的股票,基金总资产不得超过基金净资产的40%;

(14) 本基金进入全国银行间同业拆借市场进行债券回购的,其长期限不得超过一年,债券回购的资金余额不得超过基金净资产的40%;

(15) 本基金投资于国债期货的,不得超过基金净资产的14%;

(16) 本基金基金份额与股指期货交易,应当符合以下投资限制:

(17) 在任何交易日买入的股指期货合约的指定期货合约价值,不得超过基金净资产的10%;

(18) 本基金持有的股票期权,其市值不得超过基金净资产的10%;

(19) 本基金投资于商品期货、商品期权、商品掉期、商品互换的,不得超过基金净资产的10%;

(20) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(21) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(22) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(23) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(24) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(25) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(26) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(27) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(28) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(29) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(30) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(31) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(32) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(33) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(34) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(35) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(36) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(37) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(38) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(39) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(40) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(41) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(42) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(43) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(44) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(45) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(46) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(47) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(48) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(49) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(50) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(51) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(52) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(53) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(54) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(55) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(56) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(57) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(58) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(59) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(60) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(61) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(62) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(63) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(64) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(65) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(66) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(67) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(68) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(69) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(70) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(71) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(72) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(73) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(74) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(75) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(76) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(77) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(78) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(79) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(80) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(81) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;

(82) 本基金投资于境外主权类固定收益证券,不得超过基金净资产的10%;